

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年6月18日提出
【発行者名】	岡三アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 綿川 昌明
【本店の所在の場所】	東京都中央区京橋二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	中田 尚孝
【電話番号】	03-3516-1432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	日本株式・Jリートバランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	(1)当初自己設定日(平成29年9月22日) 100万円を上限とします。 (2)継続申込期間(平成29年9月22日から平成30年12月7日まで) 2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2017年 9月 6日付をもって提出した有価証券届出書（2018年 1月4日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、またその他の情報について訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

また、原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」に「中間財務諸表」の記載事項が追加され、2 ファンドの現況が更新されます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの特色

<更新後>

## 〈ファンドの目的〉

日経平均株価採用銘柄および不動産投資信託（J-REIT）に投資を行い、投資成果の獲得を目指して運用を行います。

## 〈ファンドの特色〉

**1** 日経平均株価および東証REIT指数（配当込み）を50：50とした合成指数に連動する投資成果の獲得を目指して運用を行います。

ファンドのベンチマークは合成指数です。

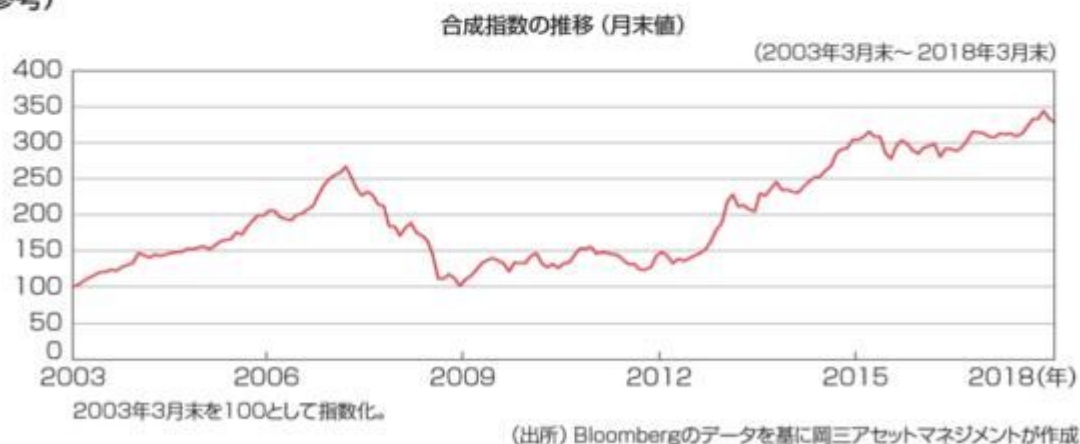
ファンドは以下のマザーファンドを通じて、日経平均株価採用銘柄および不動産投資信託（J-REIT）にそれぞれ50%程度投資を行います。

- 日本インデックスオープン225・マザーファンド
- J-REITインデックス・マザーファンド

### 合成指数とは

日経平均株価、東証REIT指数（配当込み）を50%ずつ組み合わせ、委託会社が独自に指数化したものです。

（参考）



※上記は参考データであり、ファンドの将来の運用成果を保証・示唆するものではありません。

### ベンチマークとは

ファンドの運用目標となる指標をいいます。同時に、運用成果を検証する際のパフォーマンス評価基準となります。

2

株式への投資にあたっては、日経平均株価に連動する投資成果の獲得を目指し、当該指数採用銘柄のうち200銘柄以上に、原則として等株数投資を行います。

\*流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄の組入れは行わないことがあります。また、当該指数との連動性を維持することを目的に、株価指数先物等に投資を行う場合があります。

### 日経平均株価とは

日経平均株価は、日本経済新聞社が東証一部上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象に算出・公表している株価指数であり、わが国の株式市場動向を反映する代表的な指数のひとつです。

### (参考)



※上記は参考データであり、ファンドの将来の運用成果を保証・示唆するものではありません。

※国内外の主なできごとを記載したものであり、全てを網羅したものではありません。

「日経平均株価」(日経平均)に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。本商品について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

3

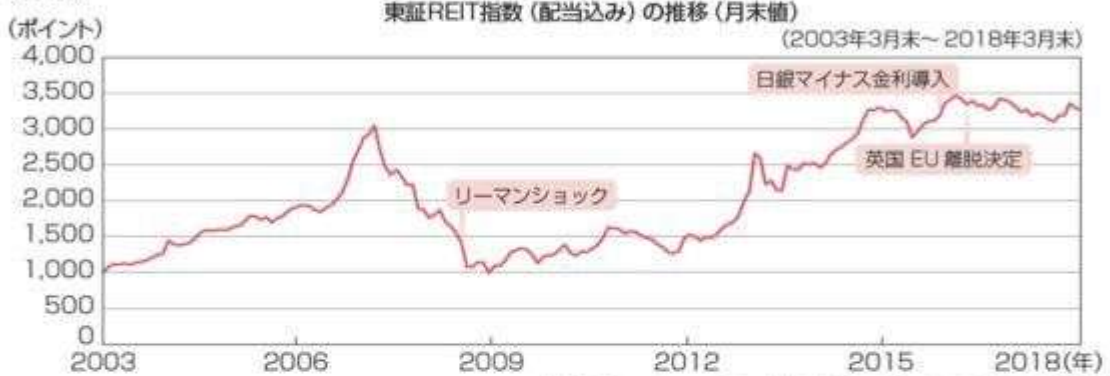
J-REITへの投資にあたっては、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果の獲得を目指し、当該指数構成銘柄に投資を行います。

\*当該指数との連動性を維持することを目的に、J-REITを投資対象とする上場投資信託証券（ETF）およびJ-REITの指数を対象とする先物等に投資を行う場合があります。

### 東証REIT指数（配当込み）とは

東証REIT指数（配当込み）は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託（J-REIT）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。

（参考）



※上記は参考データであり、ファンドの将来の運用成果を保証・示唆するものではありません。

※国内外の主なできごとを記載したものであり、全てを網羅したものではありません。

東証REIT指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（株東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数の高標又は標章に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

### 不動産投資信託について

不動産投資信託とは、投資家から集めた資金を不動産（オフィスビル、賃貸マンション、ショッピングセンター、ホテル等）に投資し、不動産から得た賃料収入や売却益などから不動産の維持・管理費用等を支払った後の収益を投資家に分配する仕組みの金融商品です。

わが国の不動産投資信託は、米国で不動産投資信託がReal Estate Investment Trustの頭文字をとって、REIT（リート）と呼ばれていることから、その日本版という意味でJ-REIT（ジェイ・リート）と呼ばれています。



資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## 分配方針

毎年9月8日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。

- 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。繰越分を含めた経費控除後の配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。
- 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して決定します。

※分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

### （ 3 ）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（ 略 ）

委託会社の概況（2017年10月末日現在）

（ 略 ）

< 訂正後 >

（ 略 ）

委託会社の概況（2018年3月末日現在）

（ 略 ）

## 2 【投資方針】

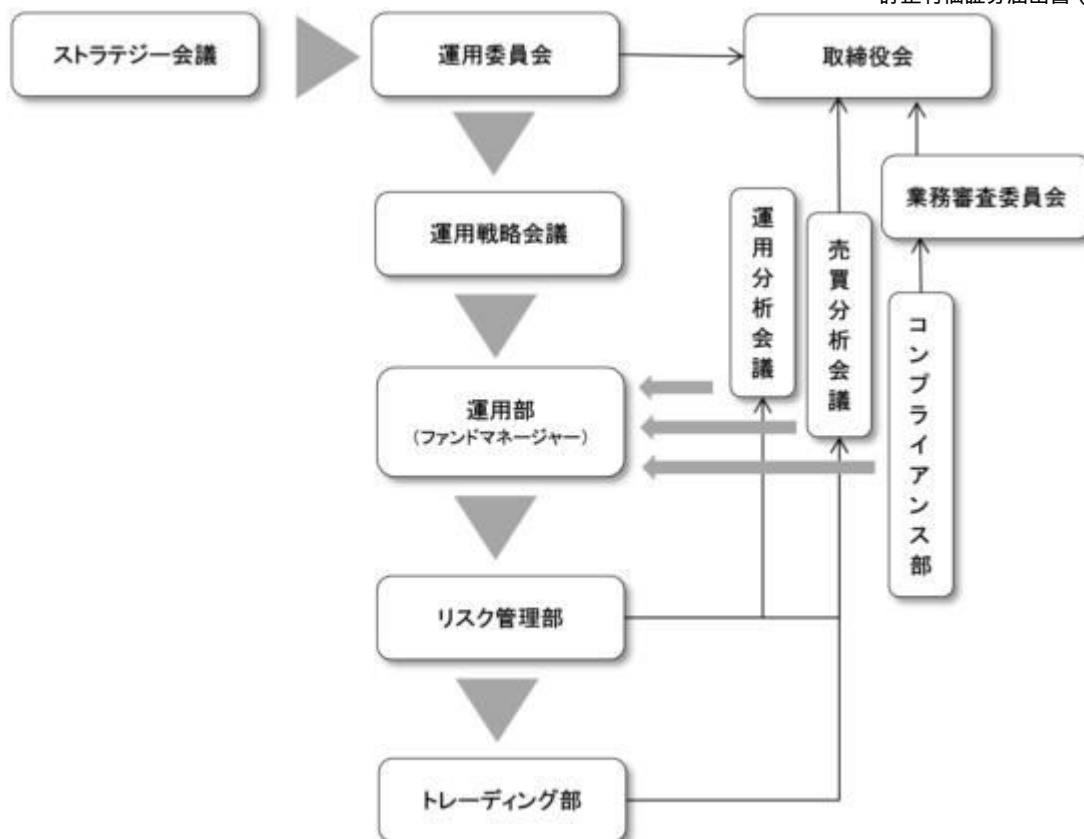
### （ 3 ）【運用体制】

< 更新後 >

運用体制、内部管理および意思決定を監督する組織

ファンドの運用体制、内部管理および意思決定を監督する組織は、以下のようになります。





会議名または部署名	役割
運用委員会 (月1回開催)	運用本部及び投資情報部で開催する「ストラテジー会議」で策定された投資環境分析と運用の基本方針案に基づいて検討を行い、運用の基本方針を決定します。また、運用に関する内規の制定及び改廃のほか、運用ガイドライン等運用のリスク管理に関する事項を決定します。委員長は審議・検討結果を取締役会へ報告します。
運用戦略会議 (月1回開催)	運用委員会で決定された運用の基本方針に基づいた個別ファンドの具体的な投資戦略について検討を行います。
運用部	ファンドマネージャーは、運用戦略会議で検討された投資戦略に基づき、ファンド毎に具体的な運用計画を策定し、運用計画・運用実施計画に基づいて、運用の指図を行います。
運用分析会議 (月1回開催)	運用のパフォーマンス向上、運用の適正性の確保、および運用のリスク管理に資することを目的に、個別ファンドの運用パフォーマンスを分析・検証・評価し、運用部にフィードバックを行います。
売買分析会議 (月1回開催)	運用財産に係る運用の適切性確保に資することを目的にファンドの有価証券売買状況や組入れ状況など、日々、リスク管理部、トレーディング部が行っている運用の指図に関するチェック状況の報告・指摘を行います。議長は会議の結果を取締役会へ報告します。
業務審査委員会 (原則月1回開催)	運用の指図において発生した事務処理ミスや社内規程等に抵触した事項などについて審議し、判断を行います。委員長はその結果を取締役会へ報告します。
コンプライアンス部 (3名程度)	運用業務にかかわる関係法令及び社内諸規則等の遵守状況の点検並びに点検結果に基づく運用本部への指導を行います。
リスク管理部 (6名程度)	「運用の指図に関する検証規程」に基づき、投資信託財産の運用の指図につき、法令諸規則等に定める運用の指図に関する事項の遵守状況の確認を行います。発注前の検証として、発注内容が法令諸規則等に照らして適当であるのか伝票又はオーダー・マネジメント・システムのコンプライアンスチェック機能を利用して確認を行い、発注後の検証として、運用指図結果の適法性又は適正性について確認を行います。



トレーディング部 (7名程度)	有価証券、デリバティブ取引等の発注に関し、法令諸規則等に基づいて最良執行に努めています。また、運用指図の結果について最良執行の観点からの検証・分析を行います。
--------------------	---

#### 社内規程

委託会社では、ファンドの運用に関する社内規程において、運用を行うに当たって遵守すべき事項等を定め、ファンドの商品性に則った適切な運用を行っています。

また、委託会社では、リスク管理規程において、運用に関するリスク管理方針を定め、運用本部及び運用本部から独立した部署が、運用の指図について運用の基本方針や法令諸規則等に照らして適切かどうかのモニタリング・検証を通じて、運用リスクの管理を行っています。

#### ファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制等

「受託会社」または「再信託受託会社」に対しては、日々の基準価額および純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っております。

運用体制等につきましては、2018年3月末日現在のものであり、変更になることがあります。

### 3【投資リスク】

( 参考情報 )

< 更新後 >

## (参考情報)

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

2013年4月末～2018年3月末



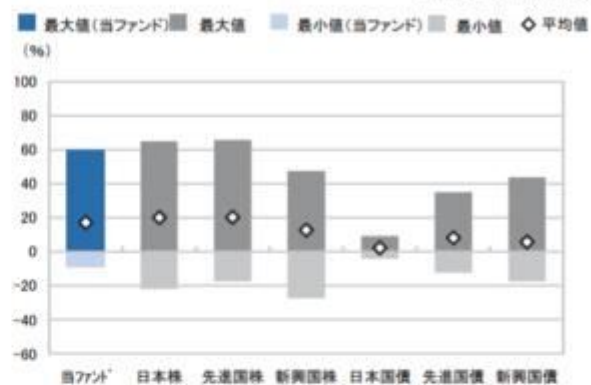
\*分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。  
分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額と異なる場合があります。

\*年間騰落率は、2013年4月から2018年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。  
なお、運用期間が1年未満であるため、対象インデックスの騰落率を表示しております。

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

グラフは、ファンドと代表的な資産のリスクを定量的に比較できるように作成したものです。

2013年4月末～2018年3月末



当ファンド<sup>\*</sup> 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	60.1	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△9.1	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	17.1	20.1	20.3	12.8	2.2	8.2	5.7

\*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
\*2013年4月から2018年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。

## 各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)  
先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)  
新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)  
日本国債・・・NOMURA-BPI国債  
先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
新興国債・・・JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)  
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## ○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

## 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

## NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

## JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

## (5)【課税上の取扱い】

## &lt;更新後&gt;

ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度、未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。

ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度の適用対象です。

## 個人受益者に対する課税

### 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金は、配当所得として、以下の税率による源泉徴収が行われます。確定申告は不要ですが、確定申告による総合課税または申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

### 償還金および解約金に対する課税

償還価額および解約価額から取得費（申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益は、譲渡所得となり、以下の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）をご利用の場合には、原則として確定申告は不要です。

償還時および解約時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能です。

償還時および解約時の差益（譲渡益）については、他の上場株式等の譲渡損と相殺することができ、損益通算が可能となります。

また、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等との損益通算も可能です。

2037年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額×2.1%相当額）がかかります。

期間	税率
2014年1月1日以降 2037年12月31日まで	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、地方税5%）

## 法人受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに償還時及び解約時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

2037年12月31日までは、復興特別所得税（所得税額×2.1%相当額）がかかります。

期間	税率
2014年1月1日以降 2037年12月31日まで	15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）
2038年1月1日以降	15%（所得税15%）

## 普通分配金、元本払戻金（特別分配金）とは

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。

基準価額（分配落）が受益者の個別元本と同額の場合または上回っている場合には、分配金の全額が普通分配金となります。

基準価額（分配落）が受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。元本払戻金（特別分配金）は、元本の一部払戻しに相当し、非課税扱いとなります。

## 個別元本とは

個別元本とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額（申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均されます。

ただし、複数の販売会社でファンドを買付けた場合は、販売会社ごとに個別元本の算出が行われます。

また、同一販売会社であっても、複数口座でファンドを買付けた場合には口座ごとに、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」を併用する場合にはコースごとに、個別元本の算出が行われることがあります。

受益者が、元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、個別元本は、分配金発生時の個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額となります。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」および2018年1月以降、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

なお、「NISA」と「つみたてNISA」は年単位で変更することも可能です。ただし、同一年中の併用はできません。

また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## その他

- ・ 原則として、配当控除の適用が可能です。
- ・ 買取請求による換金の場合の課税上の取扱い及び損益通算等につきましては、取得申込みを取り扱った販売会社にお問い合わせ下さい。

上記の内容は2018年3月末日現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合には変更になることがあります。課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

2018年 3月30日現在の運用状況は、以下の通りです。

投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。また、小数点以下第3位を四捨五入しており、合計と合わない場合があります。

### （１）【投資状況】

日本株式・Jリートバランスファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	16,241,314	99.50
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		81,078	0.50
合計(純資産総額)		16,322,392	100.00

(参考) 日本インデックスオープン225・マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	6,356,822,050	92.63
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		505,985,571	7.37
合計(純資産総額)		6,862,807,621	100.00

(参考) J-REITインデックス・マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	14,261,085,420	98.64
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		196,685,606	1.36
合計(純資産総額)		14,457,771,026	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

日本株式・Jリートバランスファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	日本インデックスオープン225・マザーファンド	3,215,683	2.5976	8,353,067	2.5300	8,135,677	49.84
2	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス・マ ザーファンド	4,189,393	1.8967	7,946,194	1.9348	8,105,637	49.66

(種類別投資比率)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.50
合計	99.50

(参考) 日本インデックスオープン225・マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	11,000	31,619.45	347,814,000	43,240.00	475,640,000	6.93
2	日本	株式	ファナック	電気機器	11,000	21,736.90	239,106,000	26,960.00	296,560,000	4.32
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	33,000	8,623.81	284,586,000	7,950.00	262,350,000	3.82
4	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,000	15,429.18	169,721,000	20,015.00	220,165,000	3.21
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	66,000	2,923.63	192,960,000	2,716.50	179,289,000	2.61
6	日本	株式	京セラ	電気機器	22,000	6,479.27	142,544,000	6,004.00	132,088,000	1.92
7	日本	株式	ダイキン工業	機械	11,000	10,981.09	120,792,000	11,735.00	129,085,000	1.88
8	日本	株式	テルモ	精密機器	22,000	4,441.18	97,706,000	5,590.00	122,980,000	1.79
9	日本	株式	信越化学工業	化学	11,000	9,852.36	108,376,000	11,005.00	121,055,000	1.76
10	日本	株式	TDK	電気機器	11,000	7,398.63	81,385,000	9,590.00	105,490,000	1.54
11	日本	株式	ユニバーファミリー マートホールディングス	小売業	11,000	5,987.63	65,864,000	8,960.00	98,560,000	1.44
12	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	55,000	1,382.81	76,055,000	1,614.00	88,770,000	1.29
13	日本	株式	花王	化学	11,000	6,895.72	75,853,000	7,981.00	87,791,000	1.28
14	日本	株式	日東電工	化学	11,000	9,365.18	103,017,000	7,978.00	87,758,000	1.28
15	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	33,000	2,473.75	81,633,889	2,644.50	87,268,500	1.27
16	日本	株式	セコム	サービス業	11,000	8,018.72	88,206,000	7,920.00	87,120,000	1.27
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	22,000	3,105.18	68,314,000	3,660.00	80,520,000	1.17
18	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	11,000	6,281.09	69,092,000	6,825.00	75,075,000	1.09
19	日本	株式	資生堂	化学	11,000	4,880.13	53,681,528	6,813.00	74,943,000	1.09
20	日本	株式	エーザイ	医薬品	11,000	5,666.36	62,330,056	6,781.00	74,591,000	1.09
21	日本	株式	トレンドマイクロ	情報・通信業	11,000	5,099.80	56,097,892	6,350.00	69,850,000	1.02
22	日本	株式	デンソー	輸送用機器	11,000	5,298.54	58,284,000	5,820.00	64,020,000	0.93
23	日本	株式	キヤノン	電気機器	16,500	3,807.02	62,815,887	3,853.00	63,574,500	0.93
24	日本	株式	スズキ	輸送用機器	11,000	5,585.49	61,440,408	5,730.00	63,030,000	0.92
25	日本	株式	アサヒグループホールディングス	食料品	11,000	4,875.72	53,632,935	5,667.00	62,337,000	0.91
26	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	55,000	1,149.37	63,215,896	1,132.00	62,260,000	0.91
27	日本	株式	コナミホールディングス	情報・通信業	11,000	5,614.19	61,756,102	5,590.00	61,490,000	0.90
28	日本	株式	塩野義製薬	医薬品	11,000	5,705.16	62,756,825	5,491.00	60,401,000	0.88
29	日本	株式	中外製薬	医薬品	11,000	4,438.08	48,818,926	5,380.00	59,180,000	0.86
30	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	11,000	4,502.55	49,528,057	5,329.00	58,619,000	0.85

## (種類別及び業種別投資比率)

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.14
		鉱業	0.08
		建設業	2.68
		食料品	4.32

繊維製品	0.27
パルプ・紙	0.14
化学	8.33
医薬品	7.03
石油・石炭製品	0.33
ゴム製品	0.94
ガラス・土石製品	1.45
鉄鋼	0.11
非鉄金属	1.24
金属製品	0.30
機械	4.86
電気機器	18.42
輸送用機器	5.85
精密機器	2.87
その他製品	1.07
電気・ガス業	0.21
陸運業	1.96
海運業	0.12
空運業	0.07
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.55
卸売業	2.08
小売業	10.25
銀行業	0.87
証券、商品先物取引業	0.36
保険業	0.86
その他金融業	0.28
不動産業	1.59
サービス業	3.81
合計	92.63

## (参考) J - R E I Tインデックス・マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,758	576,283	1,013,106,551	588,000	1,033,704,000	7.15
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	1,716	562,319	964,939,833	551,000	945,516,000	6.54
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	5,373	144,520	776,506,658	146,800	788,756,400	5.46
4	日本	投資証券	日本リートファンド投資法人 投資証券	3,429	202,232	693,456,134	204,200	700,201,800	4.84
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	4,004	163,759	655,694,639	166,800	667,867,200	4.62



6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	3,603	158,865	572,392,144	163,200	588,009,600	4.07
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	2,420	241,925	585,459,105	229,000	554,180,000	3.83
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	2,113	269,528	569,514,734	254,600	537,969,800	3.72
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	1,681	277,719	466,846,445	275,100	462,443,100	3.20
10	日本	投資証券	GLP投資法人 投資証券	3,769	116,436	438,849,620	115,700	436,073,300	3.02
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,146	385,997	442,353,593	379,000	434,334,000	3.00
12	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	5,240	73,676	386,066,798	75,700	396,668,000	2.74
13	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	821	479,164	393,393,947	472,500	387,922,500	2.68
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	531	625,461	332,120,003	653,000	346,743,000	2.40
15	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	603	444,826	268,230,126	465,500	280,696,500	1.94
16	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	618	462,189	285,633,167	433,500	267,903,000	1.85
17	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,950	136,575	266,322,030	135,600	264,420,000	1.83
18	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,210	217,368	263,015,969	218,500	264,385,000	1.83
19	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	2,109	121,472	256,185,629	119,500	252,025,500	1.74
20	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	4,980	46,210	230,129,833	49,050	244,269,000	1.69
21	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	392	552,093	216,420,531	616,000	241,472,000	1.67
22	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	1,626	132,734	215,825,776	139,700	227,152,200	1.57
23	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	1,298	173,537	225,251,285	156,300	202,877,400	1.40
24	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,233	163,471	201,560,495	163,000	200,979,000	1.39
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	1,724	115,038	198,325,649	112,300	193,605,200	1.34
26	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	1,640	107,652	176,549,739	111,600	183,024,000	1.27
27	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,217	136,819	166,509,307	146,700	178,533,900	1.23
28	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	688	233,551	160,683,156	249,000	171,312,000	1.18
29	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,042	80,725	164,840,919	81,100	165,606,200	1.15
30	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,139	131,262	149,507,839	144,500	164,585,500	1.14

## (種類別投資比率)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.64
合計	98.64

## 【投資不動産物件】

日本株式・Jリートバランスファンド

該当事項はありません。

（参考）日本インデックスオープン２２５・マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

日本株式・Ｊリートバランスファンド

該当事項はありません。

（参考）日本インデックスオープン２２５・マザーファンド

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	日経平均株価指数先物	買建	23	日本円	483,639,872	493,580,000	7.19

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

日本株式・Ｊリートバランスファンド

	純資産総額(円)		基準価額(円) (1口当たり)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2017年 9月末日	1,014,717		1.0043	
10月末日	1,286,725		1.0374	
11月末日	4,073,414		1.0693	
12月末日	6,865,487		1.0707	
2018年 1月末日	10,172,100		1.1063	
2月末日	13,028,514		1.0713	
3月末日	16,322,392		1.0583	

【分配の推移】

## 日本株式・Jリートバランスファンド

	期間	分配金 (1口当たり)
第1期中間計算期間	2017年 9月22日～2018年 3月21日	円

## 【収益率の推移】

## 日本株式・Jリートバランスファンド

	期間	収益率(%)
第1期中間計算期間	2017年 9月22日～2018年 3月21日	4.9

(注) 収益率は期間騰落率です。小数点以下第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 日本株式・Jリートバランスファンド

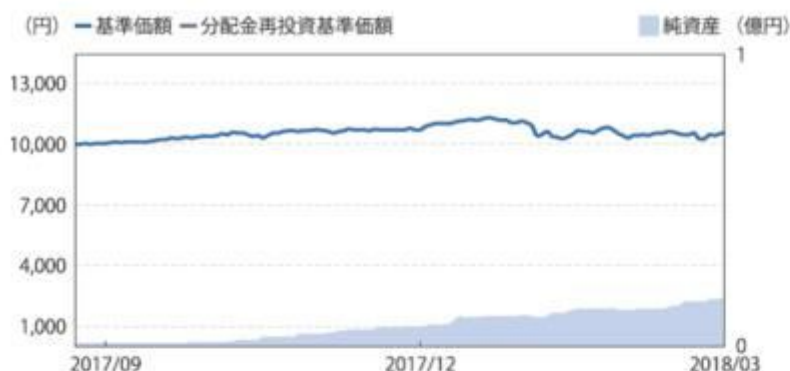
期間	設定数量(口)	解約数量(口)
第1期中間計算期間	17,072,909	2,497,257

## 参考情報

## 運用実績

2018年3月30日現在

## 基準価額・純資産の推移(2017年9月22日～2018年3月30日)



※基準価額は1万口当たり、信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、決算時の分配金を再課税で再投資したものと計算しております。  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配金の推移

-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

※上記分配金は1万口当たり、税引前です。

主な資産の状況  
組入ファンド

ファンド名	純資産比率
日本インデックスオープン225・マザーファンド	49.84%
J-REITインデックス・マザーファンド	49.66%

組入上位銘柄  
(日本インデックスオープン  
225・マザーファンド)

銘柄名	業種	純資産比率
ファーストリテイリング	小売業	6.93%
ファナック	電気機器	4.32%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.82%
東京エレクトロン	電気機器	3.21%
KDDI	情報・通信業	2.61%

※比率は日本インデックスオープン225・マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

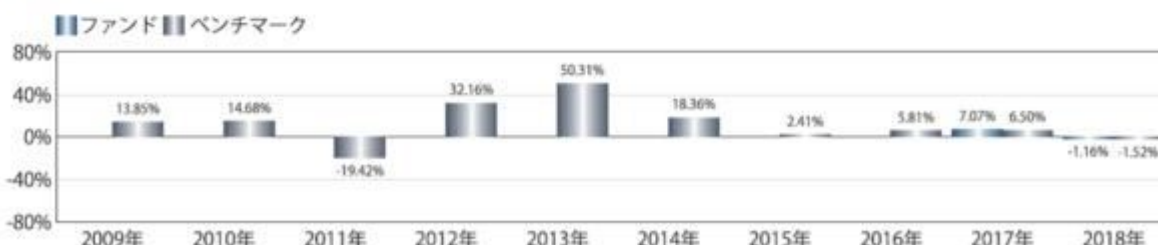
組入上位銘柄  
(J-REITインデックス・  
マザーファンド)

銘柄名	純資産比率
日本ビルファンド投資法人 投資証券	7.15%
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6.54%
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	5.46%
日本リテールファンド投資法人 投資証券	4.84%
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	4.62%

※比率はJ-REITインデックス・マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

※組入銘柄は、上位5銘柄もしくは全銘柄を記載しています。

## 年間収益率の推移



※ベンチマークは合成指数です。ベンチマークは参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。  
 ※2017年は、ファンドについては設定日から年末まで、ベンチマークについては設定日前営業日から年末までの収益率を示しています。2018年は、ファンドおよびベンチマークともに3月  
 末までの収益率を示しています。  
 ※2016年以前はベンチマークの収益率を示しています。

・過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。  
 ・最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

## 第3【ファンドの経理状況】

- 1.当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び同規則第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2.当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間（平成29年 9月22日から平成30年 3月21日まで）の中間財務諸表について、東陽監査法人により中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【日本株式・Jリートバランスファンド】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期中間計算期間末 (平成30年 3月21日現在)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	116,272
コール・ローン	71,599
親投資信託受益証券	15,107,981
流動資産合計	15,295,852
<b>資産合計</b>	
15,295,852	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	5,064
未払受託者報酬	690
未払委託者報酬	5,753
その他未払費用	278
流動負債合計	11,785
<b>負債合計</b>	
11,785	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	+114,575,652
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	708,415
元本等合計	15,284,067
<b>純資産合計</b>	
+215,284,067	
<b>負債純資産合計</b>	
15,295,852	

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	178,619
営業収益合計	178,619
<b>営業費用</b>	
支払利息	6
受託者報酬	690
委託者報酬	5,753

第1期中間計算期間 自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日	
その他費用	278
営業費用合計	6,727
営業利益又は営業損失（ ）	185,346
経常利益又は経常損失（ ）	185,346
中間純利益又は中間純損失（ ）	185,346
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	66,752
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,107,503
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,107,503
剰余金減少額又は欠損金増加額	146,990
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	146,990
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	708,415

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

期 別	第1期中間計算期間 自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

第1期中間計算期間末 (平成30年 3月21日現在)	
*1. 当該中間計算期間の末日における受益権の総数	14,575,652口
*2. 当該中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たりの純資産額	1.0486円
(10,000口当たりの純資産額)	10,486円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第1期中間計算期間 自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価に関する事項

期 別	第1期中間計算期間末 (平成30年 3月21日現在)
1. 中間貸借対照表額、時価及び差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として全て時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありせん。
2. 時価の算定方法	時価の算定方法は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。その他、コール・ローン等は短期間で決済され、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格を時価としております。

## (重要な後発事象に関する注記)

第1期中間計算期間 自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 1. 元本の移動

第1期中間計算期間末 (平成30年 3月21日現在)	
投資信託財産に係る元本の状況	
設定元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	16,072,909円
期中一部解約元本額	2,497,257円

## 2. 有価証券関係

該当事項はありません。

## 3. デリバティブ取引関係

該当事項はありません。



(参考)

当ファンドは、「日本インデックスオープン225・マザーファンド」、「J-REITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としております。中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、当該マザーファンドの受益証券です。

マザーファンドの経理状況は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

## 日本インデックスオープン225・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	期 別	注記番 号	平成30年 3月21日現在
			金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託			61,738,319
コール・ローン			275,412,517
株式			6,335,274,990
派生商品評価勘定			559,632
未収配当金			12,307,500
前払金			1,600,000
差入委託証拠金			10,880,000
流動資産合計			6,697,772,958
資産合計			6,697,772,958
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			2,173,456
未払解約金			4,659,000
未払利息			502
その他未払費用			2,012
流動負債合計			6,834,970
負債合計			6,834,970
純資産の部			
元本等			
元本		*1	2,673,880,531
剰余金			
剰余金又は欠損金( )			4,017,057,457
元本等合計			6,690,937,988
純資産合計		*2	6,690,937,988
負債純資産合計			6,697,772,958

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項 目	期 別	自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式	

期 別	自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
項 目	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は第一種金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は、日本株式・Jリートバランスファンドの中間計算期間に合わせるため、平成29年 9月22日から平成30年 3月21日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

平成30年 3月21日現在	
*1. 当該計算期間の末日における受益権の総数	2,673,880,531口
*2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たりの純資産額	2.5023円
(10,000口当たりの純資産額)	25,023円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価に関する事項

期 別	平成30年 3月21日現在
項 目	
1. 貸借対照表額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として全て時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

期 別	平成30年 3月21日現在
項 目	
2. 時価の算定方法	時価の算定方法は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。その他、コール・ローン等は短期間で決済され、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	デリバティブ取引の時価に関する契約額等については、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（その他の注記）

1. 元本の移動

平成30年 3月21日現在	
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 9月22日
期首元本額	2,497,115,445円
期首より平成30年 3月21日までの追加設定元本額	755,060,701円
期首より平成30年 3月21日までの一部解約元本額	578,295,615円
期末元本額	2,673,880,531円
平成30年 3月21日現在の元本の内訳（*）	
日本インデックスオープン225	1,582,314,153円
日本インデックス225DCファンド	829,700,256円
日経225インデックス・オープン	258,873,908円
日本株式・Jリートバランスファンド	2,992,214円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託毎の元本額

2. 有価証券関係

該当事項はありません。

3. デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

平成30年 3月21日現在

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				

	買建				
	日経平均株価指数 先物	340,320,000	-	338,720,000	1,613,824
	合計	340,320,000	-	338,720,000	1,613,824

(注)時価の算定方法

・先物取引

国内先物取引について

先物取引の残高表示は、契約額によっております。

先物取引の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

## J - R E I T インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	期 別	注記番 号	平成30年 3月21日現在
			金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託			30,814,648
コール・ローン			137,463,085
投資証券			14,159,181,950
未収入金			326,732
未収配当金			156,385,712
流動資産合計			14,484,172,127
資産合計			14,484,172,127
負債の部			
流動負債			
未払金			123,687,814
未払利息			250
その他未払費用			565
流動負債合計			123,688,629
負債合計			123,688,629
純資産の部			
元本等			
元本		*1	7,473,274,806
剰余金			
剰余金又は欠損金( )			6,887,208,692
元本等合計			14,360,483,498
純資産合計		*2	14,360,483,498
負債純資産合計			14,484,172,127

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項 目	期 別	自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		投資証券

期 別	自 平成29年 9月22日 至 平成30年 3月21日
項 目	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価に当たっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は第一種金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は、日本株式・Jリートバランスファンドの中間計算期間に合わせるため、平成29年 9月22日から平成30年 3月21日までとなっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

平成30年 3月21日現在	
*1. 当該計算期間の末日における受益権の総数	7,473,274,806口
*2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たりの純資産額	1.9216円
(10,000口当たりの純資産額)	19,216円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価に関する事項

期 別	平成30年 3月21日現在
項 目	
1. 貸借対照表額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として全て時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	時価の算定方法は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。その他、コール・ローン等は短期間で決済され、時価は帳簿価格と近似していることから、当該帳簿価格を時価としております。

（その他の注記）

## 1.元本の移動

平成30年 3月21日現在	
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 9月22日
期首元本額	6,258,373,581円
期首より平成30年 3月21日までの追加設定元本額	1,325,334,109円
期首より平成30年 3月21日までの一部解約元本額	110,432,884円
期末元本額	7,473,274,806円
平成30年 3月21日現在の元本の内訳（*）	
日本株式・Jリートバランスファンド	3,965,739円
私募14-01 J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	645,531,708円
私募14-04 J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,110,487,583円
私募14-11 J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	407,202,505円
私募15-04 J-REITインデックスファンド（一般投資家私募、適格機関投資家転売制限付）	978,994,046円
J-REIT インデックスオープン（適格機関投資家専用）	4,327,093,225円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託毎の元本額

## 2.有価証券関係

該当事項はありません。

## 3.デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

（2018年 3月30日現在）

## 日本株式・Jリートバランスファンド

資産総額	16,326,745円
負債総額	4,353円
純資産総額（ - ）	16,322,392円
発行済数量	15,422,614口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0583円

## （参考）日本インデックスオープン２２５・マザーファンド

資産総額	6,903,536,453円
負債総額	40,728,832円
純資産総額（ - ）	6,862,807,621円
発行済数量	2,712,612,607口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.5300円

## （参考）J - R E I Tインデックス・マザーファンド

資産総額	14,498,360,904円
負債総額	40,589,878円
純資産総額（ - ）	14,457,771,026円
発行済数量	7,472,381,010口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.9348円



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

< 更新後 >

（2018年3月末日現在）

(1) 資本金の額	10億円
会社が発行する株式の総数	2,600,000株
発行済株式の総数	825,000株
最近5年間ににおける主な資本金の額の増減	なし

#### (2) 委託会社の機構

##### 委託会社の意思決定機構

委託会社は、12名以内で構成される取締役会により運営されます。

取締役は、委託会社の株主であることを要しません。

取締役は、株主総会において株主によって選任され、その任期は選任後2年以内に終了する事業年度の内最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでとします。

取締役会は、社長1名を選定するほか、会長、副社長、専務取締役、および常務取締役を若干名選任することができます。また、取締役会は取締役の中から代表取締役を若干名選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として、社長が招集します。取締役会の議長は、原則として、社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席したうえで、出席した取締役の過半数をもって決めます。

##### 運用の意思決定機構

運用委員会は、月1回、運用本部及び投資情報部で開催する「ストラテジー会議」で策定された投資環境分析と運用の基本方針案に基づいて検討を行い、運用の基本方針を決定します。

また、運用に関する内規の制定及び改廃のほか、運用ガイドライン等運用のリスク管理に関する事項を決定します。委員長は審議・検討結果を取締役会へ報告します。

運用戦略会議は、月1回、運用委員会で決定された運用の基本方針に基づいた個別ファンドの具体的な投資戦略について検討を行います。

ファンドマネージャーは、運用戦略会議で検討された投資戦略に基づき、ファンド毎に具体的な運用計画を策定し、運用計画・運用実施計画に基づいて、運用の指図を行います。

運用分析会議は、月1回、運用のパフォーマンス向上、運用の適正性の確保、および運用のリスク管理に資することを目的に、個別ファンドの運用パフォーマンスを分析・検証・評価し、運用本部にフィードバックを行います。

売買分析会議は、月1回、運用財産に係る運用の適切性確保に資することを目的にファンドの有価証券売買状況や組入れ状況など、日々、リスク管理部、トレーディング部が行っている運用の指図に関するチェック状況の報告・指摘を行います。議長は会議の結果を取締役会へ報告します。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

&lt;更新後&gt;

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）及びその受益権の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資一任契約にかかる投資運用業、投資助言・代理業を行っています。

2018年3月末日現在、委託会社の運用する証券投資信託は以下のとおりです。（親投資信託を除く。）

種類	本数（本）	純資産総額(億円)
追加型株式投資信託	156	11,429
追加型公社債投資信託	3	2,306
単位型株式投資信託	69	1,950
単位型公社債投資信託	8	262
合計	236	15,949

純資産総額について、億円未満を切り捨てているため、合計と合わない場合があります。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(2)「販売会社」（資本金の額は、2017年3月末日現在）

名 称	資本金の額（百万円）	事業の内容
岡三証券株式会社	5,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	1,000	
株式会社 S B I 証券	48,323	
株式会社 しん証券さかもと	450	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社 第三銀行	37,461	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

&lt;訂正後&gt;

(略)

(2)「販売会社」（資本金の額は、2017年3月末日現在）

名 称	資本金の額（百万円）	事業の内容
岡三証券株式会社	5,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	1,000	
岡三にいがた証券株式会社	852	
株式会社 S B I 証券	48,323	
株式会社 しん証券さかもと	450	
東武証券株式会社	420	

マネックス証券株式会社	12,200	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社 第三銀行	37,461	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

### 3【資本関係】

<訂正前>

（持株比率5.0%以上を記載します。）  
該当事項はありません。

<訂正後>

（持株比率5.0%以上を記載します。）  
委託会社は、岡三にいがた証券株式会社の株式を440,000株（持株比率6.31%）保有しています。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成30年5月10日

岡三アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

東陽監査法人

指定社員 公認会計士 宝金正典 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 猿渡裕子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている「日本株式・Jリートバランスファンド」の平成29年9月22日から平成30年3月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、「日本株式・Jリートバランスファンド」の平成30年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年9月22日から平成30年3月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

岡三アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月22日

岡三アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

東陽監査法人

指定社員 公認会計士 鈴木基仁 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 猿渡裕子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている岡三アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、岡三アセットマネジメント株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月1日

岡三アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

東陽監査法人

指定社員 公認会計士 鈴木基仁 印  
業務執行社員指定社員 公認会計士 猿渡裕子 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている岡三アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、岡三アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- (注)1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。